

BlackRock® 贝莱德

贝莱德ESG 多元资产基金

2023年10月

晨星5星星级评价*



*资料来源:晨星,2023年10月31日。A2美元对冲。晨星基金表现综合星级评价:为至少有36个月回报率数据的基金,分别计算3年、5年和10年的星级评价,再以此三个不同年期的评级结果,加权计算出该基金的综合评级。该评级不代表基金未来表现。

整合ESG因子 纳入投资流程



步骤一 严格筛选

排除10个具有争议的行业
与违反联合国全球盟约之标的

争议性武器	温室燃煤	一般武器	烟草
酒类	赌博	武器	核能
成人娱乐	油砂开采		



步骤二 优中选优

基金仅投资于MSCI ESG评级BBB以上的企业*

AAA	AA	A	BBB
BB	B	CCC	



步骤三 额外加仓优势主题

- 通过ESG主题投资组合分散风险,同时推动积极的环境及社会转变。
- 另类投资纳入具有社会价值之标的,例如社会住宅及可再生能源。

本基金符合以下ESG评级标准

- 欧盟永续金融规范(SFDR) Article 8: 具备以促进环境、社会或公司治理等特质为产品之投资重点。
- 晨星永续基金评级 : 晨星为各档基金分出五个评级,用以衡量这些基金在过去几年持股的ESG特征,五颗地球排名最高,代表在晨星全球组别永续投资表现为前10%。

资料来源:贝莱德, MSCI, 晨星, *ESG评级由MSCI决定。
**晨星,截至2023年10月31日。

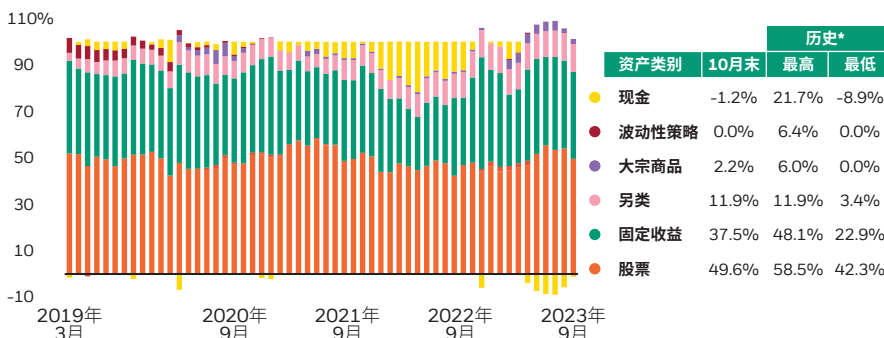
blackrock.com/cn

为何投资本基金?

1 囊括多元资产,投资组合灵活布局

本基金平衡配置股票、债券、另类资产、大宗商品及波动性策略,以获取多元化收益。

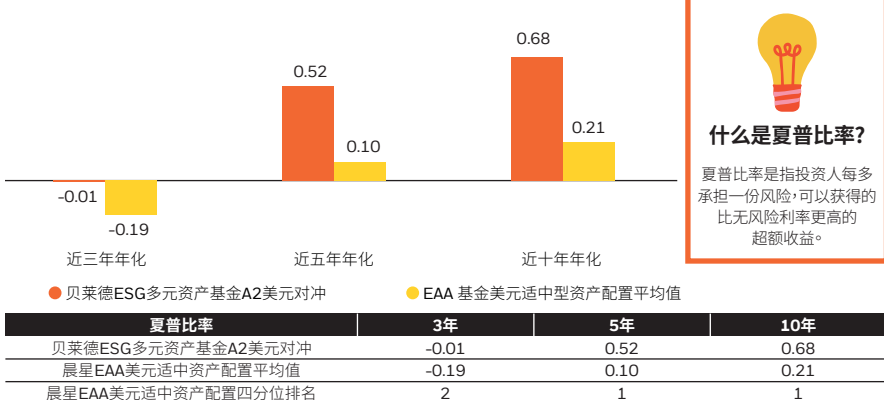
贝莱德ESG多元资产基金的资产配置



资料来源:贝莱德,截至2023年10月31日。以上数据仅供说明。多元化资产配置可能无法完全保护您免受市场风险的影响。*仅呈现2019年1月19日至2023年10月31日期间的历史最高和最低配置。

2 投资性价比高: 夏普比率(年化) 优于同类型基金

基金夏普比率优于晨星同类型基金



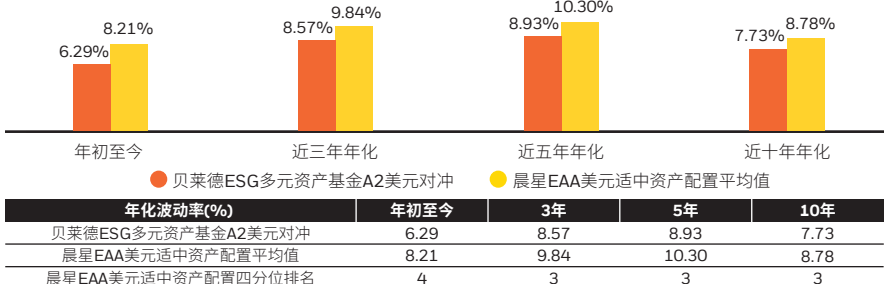
什么是夏普比率?

夏普比率是指投资人每多承担一份风险,可以获得的比无风险利率更高的超额收益。

资料来源:晨星,截至2023年10月31日,晨星同类型基金为晨星EAA美元适中型资产配置,取其表现平均值。夏普比率以A2美元对冲累积股份为例,按美元资产净值计算,将股息再作投资,已扣除基金应承担之相关费用。投资涉及风险,基金过去表现不代表其未来表现,亦不保证基金最低投资收益。四分位排名是以百分位排名大于0且小于等于25为第一区间,大于25且小于等于50为第二区间,以此类推。

3 年化波动率显著低于同类型基金平均

长期来看,基金波动率低于晨星同类型基金



资料来源:晨星,截至2023年10月31日,晨星同类型基金为晨星EAA美元适中型资产配置,取其表现平均值。年化波动率以A2美元对冲累积股份为例,按美元资产净值计算,将股息再作投资,已扣除基金应承担之相关费用。投资涉及风险,基金过去表现不代表其未来表现,亦不保证基金最低投资收益。四分位排名是以百分位排名大于0且小于等于25为第一区间,大于25且小于等于50为第二区间,以此类推。

基金经理
Jason Byrom
Conan Mckenzie

基金总值
5,428.14百万欧元
(截至2023年10月31日)

成立日期
2010年4月16日(A2美元对冲)

股份类别
美元对冲/人民币对冲/
新加坡元对冲

彭博/ISIN股份代码
A2美元对冲
BGFSAA2/ LU0494093205

A10美元对冲
BGEMAAU/ LU2452424414

A10人民币对冲
BGEMAAU/ LU2452424687

A10新加坡元对冲
BGEMAAH/ LU2452424505

过去十二个月平均派息率

A10美元对冲: **4.37%**

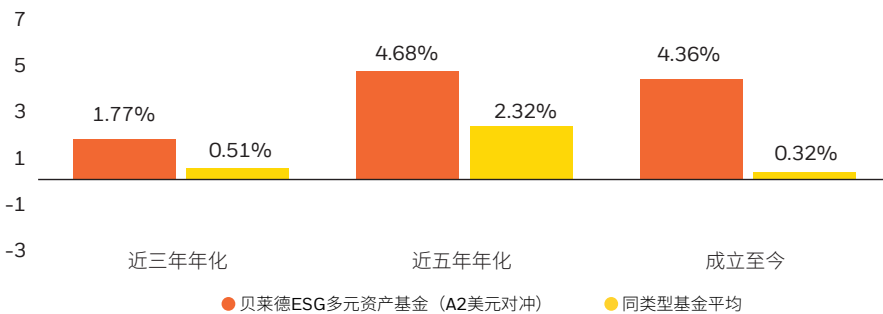
A10新加坡元对冲: **4.29%**

A10人民币对冲: **4.79%**

资料来源:贝莱德, 2023年10月底。股息不获保证, 而A10股份类别可能从资本支付。股息支付会导致基金的每股资产净值在除息日减少。

本基金长期表现有目共睹

基金年化回报率 % (A2 美元对冲)



	3年	5年	成立至今
本基金年化回报率(%)	1.77	4.68	4.36
同类型基金平均年化回报率(%)	0.51	2.32	0.32

显示的数字与过去表现相关。过往业绩并非当前或未来业绩的可靠指标,亦不应成为选择产品或投资策略时的唯一考虑因素。投资涉及风险,基金过去表现不代表其未来表现,亦不保证基金最低投资收益。资料来源:贝莱德、晨星,截至2023年10月31日。同类型基金为晨星EAAOE USD Moderate Allocation。累积表现以A2美元对冲累积股份为例,该类股成立日为2010年4月16日。按美元资产净值计算,将派息再作投资,已扣除基金应承担之相关费用。

十大持仓(%)

公司名称	比重(%)
MICROSOFT CORP (微软)	4.95
GREENCOAT UK WIND PLC	3.94
ISHARES PHYSICAL GOLD	2.23
SYNCONA LIMITED LTD NPV	1.70
GNMA2 30YR	1.29
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) 0 08/15/2031	1.19
EUROPEAN UNION MTN RegS 0 03/04/2026	1.15
Alphabet (谷歌母公司)	1.13
GREENCOAT RENEWABLES PLC	1.13
MASTERCARD INC CLASS A	1.06
总计	19.77

资料来源:贝莱德,资料截至2023年10月31日。本文所提及之有价证券仅供举例说明之用,不代表任何金融商品之推介或建议,亦不代表基金未来投资。投资分布会随市场变化而调整。投资人申购本基金系持有基金受益凭证,而非本文提及之投资资产或标的。

投资组合一览



资料来源:贝莱德,资料截至2023年10月31日。信用评级计算系以资料截止日之固定收益持仓市值占比加权平均计算而得(含无评级)。基金为主动式管理基金,其投资分布会随市场变化而调整。由于四舍五入所致,总额可能不等于100%。投资人申购本基金系持有基金受益凭证,而非本文提及之投资资产或标的。本基金之固定收益持仓信用评级,使用标准普尔(S&P)信用评级计算本基金债券持仓之平均信用评级。各评等债券占本基金相关比重如下:AAA(5.9%),AA+(11.5%),AA-(0.6%),AA(2.8%),A+(1.2%),A-(3.5%),A(2.5%),BBB+(3.8%),BBB(2.1%),BBB-(0.5%),BB+(0.2%),BB-(0.9%),BB(0%),无评级(3.4%)。*含贵金属ETC。**本基金运用期货或期权等衍生性商品来快速提高投资组合的风险持仓或为投资组合进行避险。当实际投资仓位与衍生性商品名义持仓总和超过100%时,净现金比重可能呈现负值。上述包括内部投资限制并可能随时更改而不予通知,投资策略请详基金公开说明书。投资人应留意衍生性工具/证券相关商品等杠杆投资策略所可能产生之投资风险(详见公开说明书或投资人须知)。

本文所载之基金乃贝莱德全球基金的子基金。信息来源:晨星,贝莱德, DATASTREAM。以美元按资产净值比资产净值基础计算,将收入再作投资。基金表现数据的计算已扣除费用。上述基金表现仅作参考之用。投资涉及风险。过往业绩并不代表将来的表现,基金价格及其收益可升可跌,并不能保证。投资价值亦可能受到汇率影响。投资者可能无法取回原本投资金额。个别股票价格并不代表本基金的回报。本基金数据提供的任何关于贝莱德ESG多元资产基金的信息仅供参考,并仅与投资于银行的财富管理产品相关。本基金数据上的任何信息不构成招揽任何人直接投资贝莱德ESG多元资产基金的要约邀请。贝莱德ESG多元资产基金的发行人及经理人对银行的财富管理产品的合法性和适当性不负责任,且对银行的财富管理产品投资项目的投资者所作的投资决策不负责任。基金尽力提供高收益,而支付利息可能导致基金资本流失。基金赚取收入的投资策略或会减低基金资本增长潜力以及将来的收入。基金投资于股票,较大的股票价值波动可招致重大亏损。基金赚取收入的投资策略或会减低基金资本增长的潜力以及将来的收入。本文件数据并不构成招揽任何人对本文件所述之投资项目做出投资。投资者在投资本档内提及的任何项目前应细阅相关中华人民共和国的商业银行根据中国银行业监督管理委员会相关法规发行的理财产品投资的法律文件。如有需要请透过相关中华人民共和国的商业银行及/或其他专业顾问寻求专业咨询。基金的权益不得在中华人民共和国(“中国”,就本文件而言,不适用于香港、澳门和台湾)境内直接或间接地要约或销售。本文件或其中包含或援引的任何有关基金权益的信息在中国均不构成任何销售证券的要约或购买证券的要约邀请。本文件、其中包含的任何信息或基金权益尚未,且将不会,向中国的任何有关政府机关进行提交或登记,或经任何中国政府机关批准或核准,因此,其不得向中国的公众提供或用于与任何在中国销售基金权益的要约有关的行为。基金权益只能由有权投资于此类基金的中国投资人投资。投资人负责自行从有关政府机关(包括但不限于:国家外汇管理局、中国证券监督管理委员会、中国银行业监督管理委员会以及其他相关监管主体)处获得所有相关的政府审批、核准、许可或登记(如有),且遵守所有适用的中国法规,包括但不限于任何相关外汇管理规定和/或境外投资规定。BLACKROCK®乃BLACKROCK, INC.或其附属公司在美国及其他地方的注册商标。所有其他交易商标、服务商标或注册商标乃为所属者拥有。©2023 BLACKROCK, INC.版权所有。

BlackRock
贝莱德